

Angaben nach dem Pfandbriefgesetz

Deckungsrechnung

Mio €	30.09.2010			30.09.2009		
	Nennwert	Barwert	Risiko- barwert	Nennwert	Barwert	Risiko- barwert
Schiffspfandbriefe						
Zu deckende Verbindlichkeiten	4.570,2	4.953,3	5.132,1	4.706,3	4.989,3	5.255,6
<i>(davon Pfandbriefumlauf)</i>	<i>4.570,2</i>	<i>4.934,6</i>	<i>5.113,6</i>	<i>(4.706,3)</i>	<i>(4.964,3)</i>	<i>(5.231,5)</i>
<i>(davon Derivate)*)</i>		<i>(18,8)</i>	<i>(18,5)</i>		<i>(25,0)</i>	<i>(24,1)</i>
Deckungswerte	5.916,8	6.264,6	6.283,1	5.409,3	5.741,9	5.777,4
<i>(davon Deckungsdarlehen)</i>	<i>(5.299,2)</i>	<i>(5.605,2)</i>	<i>(5.610,6)</i>	<i>(5.088,5)</i>	<i>(5.372,4)</i>	<i>(5.400,8)</i>
<i>davon weitere Deckungswerte (§ 26 PfandBG)</i>	<i>(307,0)</i>	<i>(327,1)</i>	<i>(331,7)</i>	<i>(152,3)</i>	<i>(163,8)</i>	<i>(166,3)</i>
<i>(davon Derivate)*)</i>	<i>(202,8)</i>	<i>(217,2)</i>	<i>(223,8)</i>	<i>(57,4)</i>	<i>(82,1)</i>	<i>(84,0)</i>
Risikobarwert nach Zinsstresstest			1.151,0			521,8
Fehlbetrag aus Währungsstresstest			-3,7			-6,3
Über-/ Unterdeckung	1.346,6	1.311,3	1.147,3	703,0	752,6	515,5
Öffentliche Pfandbriefe						
Pfandbriefumlauf	1.423,5	1.680,0	1.838,5	1.445,3	1.573,8	1.809,3
Deckungswerte	1.613,9	1.826,2	1.937,1	1.595,8	1.716,9	1.871,8
<i>(davon Deckungsdarlehen)</i>	<i>(1.156,2)</i>	<i>(1.300,8)</i>	<i>(1.376,6)</i>	<i>(1.261,2)</i>	<i>(1.364,3)</i>	<i>(1.478,7)</i>
<i>(davon weitere Deckungswerte (§ 20 Abs. 2 PfandBG))</i>	<i>(0,0)</i>	<i>(0,0)</i>	<i>(0,0)</i>	<i>(0,0)</i>	<i>(0,0)</i>	<i>(0,0)</i>
<i>(davon Derivate)</i>	<i>(0,0)</i>	<i>(0,0)</i>	<i>(0,0)</i>	<i>(0,0)</i>	<i>(0,0)</i>	<i>(0,0)</i>
Überdeckung	190,4	146,2	98,6	150,5	143,1	62,5

*) ausschließlich zur Absicherung von Währungsrisiken

Laufzeitstruktur

Mio €	30.09.2010	30.09.2009
Schiffspfandbriefe		
Pfandbriefumlauf mit einer Restlaufzeit von		
bis zu einem Jahr	281,1	392,3
mehr als einem bis zu zwei Jahren	626,2	1.417,0
mehr als zwei bis zu drei Jahren	638,2	379,8
mehr als drei bis zu vier Jahren	614,2	190,0
mehr als vier bis zu fünf Jahren	517,3	113,4
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	847,6	1.371,5
mehr als zehn Jahren	1.045,6	842,3
	4.570,2	4.706,3
Deckungswerte mit einer restlichen Zinsbindungsfrist von		
bis zu einem Jahr	4.665,5	5.036,8
mehr als einem bis zu zwei Jahren	975,5	163,4
mehr als zwei bis zu drei Jahren	131,1	102,6
mehr als drei bis zu vier Jahren	93,3	59,3
mehr als vier bis zu fünf Jahren	18,9	39,8
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	29,0	7,4
mehr als zehn Jahren	3,5	0,0
	5.916,8	5.409,3
Öffentliche Pfandbriefe		
Pfandbriefumlauf mit einer Restlaufzeit von		
bis zu einem Jahr	21,7	0,0
mehr als einem bis zu zwei Jahren	133,9	18,6
mehr als zwei bis zu drei Jahren	17,4	158,9
mehr als drei bis zu vier Jahren	14,3	17,4
mehr als vier bis zu fünf Jahren	120,1	14,3
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	267,0	329,9
mehr als zehn Jahren	849,1	906,2
	1.423,5	1.445,3
Deckungswerte mit einer restlichen Zinsbindungsfrist von		
bis zu einem Jahr	442,5	289,7
mehr als einem bis zu zwei Jahren	103,1	225,6
mehr als zwei bis zu drei Jahren	143,0	78,1
mehr als drei bis zu vier Jahren	122,3	143,0
mehr als vier bis zu fünf Jahren	97,2	122,3
mehr als fünf bis zu zehn Jahren	280,3	266,8
mehr als zehn Jahren	425,5	470,3
	1.613,9	1.595,8

Forderungen zur Deckung von Schiffspfandbriefen

Größenklassen

Mio €	30.09.2010	30.09.2009
bis zu 500 Tsd €	10,6	15,8
von mehr als 500 Tsd € bis zu 5 Mio €	1.014,5	1.011,8
von mehr als 5 Mio €	4.891,7	4.381,7
	5.916,8	5.409,3

Registerland der beliehenen Schiffe und Schiffsbauwerke

Mio €	30.09.2010	30.09.2009
Seeschiffe		
Antigua und Barbuda	18,1	10,3
Bahamas	250,1	266,8
Chile	3,0	4,6
Deutschland	2.247,5	2.298,0
Gibraltar	19,3	19,5
Griechenland	473,2	441,9
Großbritannien	92,9	66,2
Hongkong	207,3	196,7
Insel Man	51,6	65,9
Israel	0,0	0,0
Italien	163,8	156,5
Kaimaninseln	4,6	4,8
Liberia	322,5	297,0
Malta	267,6	237,6
Marshallinseln	532,4	477,9
Niederlande	66,0	69,9
Norwegen	71,6	0,0
Österreich	0,0	0,0
Panama	198,7	190,4
Portugal	2,6	6,7
Singapur	52,4	41,7
Türkei	15,3	20,3
Vanuatu	3,2	0,0
Zypern	235,5	215,8
	5.299,2	5.088,5
Binnenschiffe		
Deutschland	0,0	0,0
Gesamt	5.299,2	5.088,5

Forderungen zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen

Sitz der Schuldner bzw. der gewährleistenden Stellen

Mio €	30.09.2010	30.09.2009
Staaten		
Belgien	25,0	0,0
Griechenland	0,0	45,0
Italien	84,4	57,6
Litauen	10,0	10,0
Polen	40,0	0,0
Spanien	20,0	20,0
Ungarn	20,0	20,0
	199,4	152,6
Regionale Gebietskörperschaften		
<i>(ausschl. mit Sitz in Deutschland)</i>	732,6	702,6
Sonstige Schuldner		
mit Sitz in:		
Deutschland	539,4	598,1
Griechenland	27,5	27,5
Japan	10,0	10,0
Irland	25,0	25,0
Österreich	70,0	70,0
Slowenien	10,0	10,0
	681,9	740,6
	1.613,9	1.595,8

Rückständige Leistungen

Rückständige Leistungen (*Rückstand mindestens 90 Tage*) lagen wie im Vorjahr nicht vor.